

Berechnung CVA

Fonds: 2496T2 Capitulum Weltzins-Invest Universal AK I
 Währung: EUR
 ISIN: DE000A2H7NU1
 LEI: 529900Q626RC55DLB570
 Fondsvermögen: 268.731.980,05
 Anteile in Umlauf: 3.211.098

Auswertung per: 20.1.2026 23:45
 Bewertungsdatum: 20.1.2026 23:45

Kontrahent ID	Kontrahent	Kontrahent-LEI	KSA Bonitätsstufe Kontrahent	Risikogewicht je Kontrahent (RW)	Standard CVA-Risiko SCVA	Term 1 Fonds (Zwischenergebnis)	Term 2 Fonds (Zwischenergebnis)	CVA-Risiko im Rahmen des Basisansatzes - unhedged BACVA	CVA-Risiko im Rahmen des Basisansatzes - total BACVA	total BACVA in % FV	Zielfonds Anzahl Gegenparteien
871001	BNP Paribas S.A.	R0MUWSFPU8MPRO8K5P	2	5,00	13.819,48	1.054.103.725,21	2.102.748.748,49	36.520,82	36.520,82	0,01	0
805250	J.P. Morgan SE	549300ZK53CNGEEL6A29	1	5,00	51.114,45	1.054.103.725,21	2.102.748.748,49	36.520,82	36.520,82	0,01	0
Total								36.520,82	36.520,82	0,01	
								davon OTC:			
								1.652.400,94		0,61	

Fondsvolumen inkl. Forderungen	268.731.980,05
- Fondsvolumen aus Bewertung	268.731.980,05
Differenz	-0,00

CVA-Risiko Betrag aus OTC-Derivaten
 Betrag Summe der Risikopositionswerte (OTC-Derivate mit CVA-Charge)
 Betrag Eigenmittelanforderung aus dem Gegenparteiausfallrisiko der OTC-Derivate mit CVA-Relevanz
 Betrag Nominalbetrag CVA-Geschäfte

in % **Formular C25.01**
 0,01 Zeile 20; Spalte 70
 0,61 Zeile 20; Spalte 10
 0,14 Zeile 20; Spalte 20
 7,52 Zeile 20; Spalte 30

268.731.980,05 default: Marktwert des Fonds --> mit Buchwert überschreiben
Betrag in Buchwert:
 36.520,68
 1.652.400,70
 367.638,79
 20.198.887,24

ZUSATZINFORMATIONEN:
 Gruppeninterne Geschäft: CVA-Risiko Betrag aus OTC-Derivaten
 Gruppeninterne Geschäft: Betrag Summe der Risikopositionswerte
 Gruppeninterne Geschäft: Betrag Eigenmittelanforderung aus dem Gegenparteiausfallrisiko
 CVA-Risiko Betrag aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften
 Betrag Summe der Risikopositionswerte (Wertpapierfinanzierungsgeschäfte mit CVA-Charge)
 Betrag Eigenmittelanforderung aus dem Gegenparteiausfallrisiko der Wertpapierfinanzierungsgeschäfte mit CVA-Relevanz

0,00 Zeile 40 u. 90; Spalte 70
 0,00 Zeile 40 u. 90; Spalte 10
 0,00 Zeile 40 u. 90; Spalte 20
 0,00 Zeile 130; Spalte 70
 0,00 Zeile 130 Spalte 10
 0,00 Zeile 130; Spalte 20

-
 -
 -
 -
 -
 -